

方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证
券投资基金（LOF）
2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：方正富邦基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	57

§11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）
基金简称	方正富邦沪深港通大湾区综指（LOF）
场内简称	湾区 LOF
基金主代码	167302
基金运作方式	契约型、上市开放式（LOF）
基金合同生效日	2019 年 9 月 26 日
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,849,295.26 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 1 月 6 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。组合复制策略即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。替代性策略即对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得对个别成份股足够数量的投资时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股、成份股个股衍生品等方式进行替代。
业绩比较基准	恒生沪深港通大湾区综合指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金通过港股通投资于香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		方正富邦基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋金强	李申
	联系电话	010-57303988	021-60637102
	电子邮箱	jiangjq@founderff.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-0990	021-60637111
传真		010-57303718	021-60635778
注册地址		北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼11层（11）1101内02-11单元	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼11层02-11房间	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100101	100033
法定代表人		何亚刚	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.founderff.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路222号30楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	982,262.58
本期利润	-42,310.04
加权平均基金份额本期利润	-0.0054
本期加权平均净值利润率	-0.43%
本期基金份额净值增长率	-0.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	1,676,895.30
期末可供分配基金份额利润	0.2136
期末基金资产净值	9,526,190.56
期末基金份额净值	1.2136
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	21.36%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

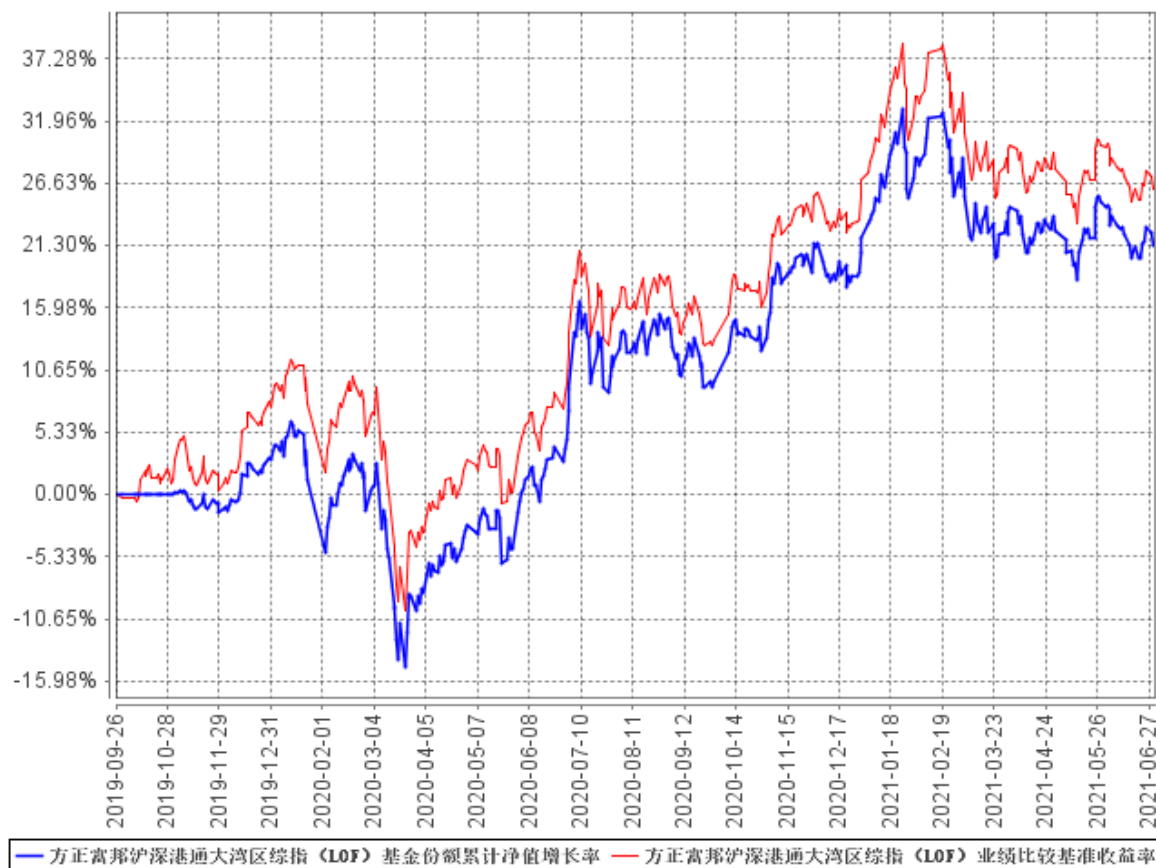
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-2.58%	0.61%	-2.67%	0.61%	0.09%	0.00%
过去三个月	-0.76%	0.76%	-1.00%	0.77%	0.24%	-0.01%
过去六个月	-0.47%	1.02%	-0.53%	1.02%	0.06%	0.00%
过去一年	16.75%	1.07%	16.26%	1.04%	0.49%	0.03%
自基金合同生效起至今	21.36%	1.17%	26.22%	1.16%	-4.86%	0.01%

注：方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）证券投资基金业绩比较基准为：恒生沪深港通大湾区综合指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

方正富邦沪深港通大湾区综指（LOF）基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为方正富邦基金管理有限公司。方正富邦基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证券监督管理委员会批准（证监许可【2011】1038号）于2011年7月8日成立。本公司注册资本6.6亿元人民币。本公司股东为方正证券股份有限公司，持有股份比例66.7%；富邦证券投资信托股份有限公司，持有股份比例33.3%。

截止2021年6月30日，本公司管理30只公开募集证券投资基金：方正富邦创新动力混合型证券投资基金、方正富邦红利精选混合型证券投资基金、方正富邦货币市场基金、方正富邦金小宝货币市场证券投资基金、方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金、方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金、方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金、方正富邦深证100交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦丰利债券型证券投资基金、方正富邦富利纯债债券型发起式证券投资基金、方正富邦深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、方正富邦信泓灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦天睿灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦天鑫灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦天恒灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦沪深300交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）、方正富邦添利纯债债券型证券投资基金、方正富邦中证主要消费红利指数增强型证券投资基金（LOF）、方正富邦天璇灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦科技创新混合型证券投资基金、方正富邦恒利纯债债券型证券投资基金、方正富邦新兴成长混合型证券投资基金、方正富邦禾利39个月定期开放债券型证券投资基金、方正富邦ESG主题投资混合型证券投资基金、方正富邦中证500指数增强型证券投资基金、方正富邦策略精选混合型证券投资基金、方正富邦汇福一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金，同时管理多个私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴昊	指数投资部总经理 兼本基金基金经理	2019年9月26日	-	6年	本科毕业于北京邮电大学，研究生毕业于北京邮电大学，2014年9月至2018年4月于华夏基金管理有

				<p>限公司数量投资部任副总裁；2018 年 4 月至 2019 年 6 月于方正富邦基金管理有限公司指数投资部任部门副总经理（主持工作）。2019 年 6 月至报告期末于方正富邦基金管理有限公司指数投资部任部门总经理。2018 年 6 月至报告期末，任方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金（自 2021 年 1 月 1 日起已变更为方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金）的基金经理，2018 年 11 月至报告期末，任方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2018 年 11 月至 2021 年 4 月，任方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 1 月至 2021 年 4 月，任方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2019 年 3 月至 2021 年 4 月，任方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2019 年 5 月至报告期末，任方正富邦红利精选混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦天鑫灵活配置混合</p>
--	--	--	--	---

				<p>型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦天睿灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦天恒灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月，任方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2019 年 11 月至报告期末，任方正富邦中证主要消费红利指数增强型证券投资基金（LOF）的基金经理。2020 年 1 月至 2021 年 4 月，任方正富邦天璇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月至报告期末，任方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金经理。2020 年 10 月至报告期末，任方正富邦科技创新混合型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月至报告期末，任方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。2021 年 1 月至报告期末，任方正富邦 ESG 主题投资混合型证券投资基金基金</p>
--	--	--	--	--

					经理。
张超梁	本基金基金经理	2021年2月2日	-	7年	<p>本科毕业于北京邮电大学，研究生毕业于中国科学院数学与系统科学研究院，2013年7月至2019年4月于国金基金管理有限公司任职，历任职位为量化分析师助理、量化分析师、投资经理、基金经理助理；2019年4月至2019年6月于华夏基金管理有限公司任产品经理；2019年6月至2019年11月于方正富邦基金管理有限公司指数投资部任基金经理助理。2019年11月至2019年12月，任拟任基金经理。2019年12月至报告期末，任方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020年3月至报告期末，任方正富邦沪深300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年2月至报告期末，任方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2021年4月至报告期末，任方正富邦深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p>

注：1. “任职日期”和“离任日期”分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
3. 本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内无此情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规及基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》的规定，通过系统和人工等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。

在投资决策内部控制方面，本基金管理人建立了统一的投资研究管理平台和全公司适用的投资对象备选库和交易对象备选库，确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度，通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式，使不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行控制方面，本基金管理人实行集中交易制度，交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先，价格优先的原则严格执行所有指令，确保公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易，按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制制度，报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度受外围美股波动、美债收益率上行以及国内流动性状况预期有所降温等因素影响，市场明显走弱，农历新年之后市场更是出现明显回调。二季度受益于疫苗的大范围接种、外需的持续拉动、通胀预期有所降温等因素影响，二季度中国经济延续了恢复性增长的态势，经济运行较为平稳。证券市场由于一季度出现较大幅度的调整，A 股估值压力逐步得到释放后估值已趋于合

理区间，叠加市场对于通胀担忧有所缓解，二季度市场呈现震荡向上的走势。2021 年 A 股的核心机会在于盈利修复，终端需求启动有望拉动中下游行业利润。与市场整体走势相比，市场结构化机会显得更为重要，在景气度长期向好的行业板块中寻找估值和盈利匹配的优质个股进行配置将是获取超额收益的重要机会。港股市场受益于疫苗周期启动，盈利端恢复，中概股回归等因素，港股市场总体风险可控，调整后有望震荡向上。

本基金跟踪的标的指数为恒生沪深港通大湾区综合指数，恒生沪深港通大湾区综合指数，覆盖于香港和/或中国内地上市、并主要在粤港澳大湾区（大湾区）营运的公司。大湾区包括九个城市和两个特别行政区—香港、澳门、广州、深圳、珠海、佛山、中山、东莞、肇庆、惠州和江门。该指数由 250 只成份股公司构成，选股范围为具有互联互通交易资格且主要在九市二区营运的港股及 A 股公司，以综合反映大湾区上市公司的整体状况。

本基金主要采取组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，力争实现基金投资目标。报告期内，本基金所跟踪的恒生沪深港通大湾区综合指数下跌 0.6%。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成分股调整事项，保障基金的正常运作，基金跟踪误差以及日均偏离度等指标控制在合同规定范围之内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2136 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.47%，业绩比较基准收益率为-0.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为国内证券市场的政策基础不断优化、流动性和经济增长总体有望继续保持良好态势，上半年行情的震荡和盘整一定程度上消化了部分板块的结构性估值泡沫，部分景气度持续向好的行业和板块体现出了一定的比较优势。展望后市，产业红利、政策导向和个股盈利修复的确定性有望进一步上升，市场整体的活跃度有望在增量配置资金流入的背景下得以延续，且终端需求启动有望拉动中下游行业利润持续增长。在估值和成长性相对比较优势更加重要的未来，市场结构化机会显得更为重要，在景气度长期向好的行业板块中寻找估值和盈利匹配的优质个股进行配置将是获取收益的重要机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估

值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、研究部负责人、基金运营部负责人及合规与风险管理部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。参与估值流程的各方还包括本基金托管人，托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金(LOF)基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未进行分红。

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，曾于 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日出现了连续二十个工作日资产净值低于五千万的情况。同时截止到报告期末，本基金连续六十个工作日基金资产净值低于五千万。本基金管理人拟定的解决方案为持续营销，已将解决方案上报证监会。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本报告期，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,062,361.90	1,334,977.12
结算备付金		18,759.40	795.49
存出保证金		1,818.77	8,616.16
交易性金融资产	6.4.7.2	8,971,063.03	11,429,485.70
其中：股票投资		8,971,063.03	11,429,485.70
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	175,950.27
应收利息	6.4.7.5	73.23	165.93
应收股利		13,125.31	3,119.45
应收申购款		4,206.35	1,085.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,071,407.99	12,954,196.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		375,833.65	2.36
应付赎回款		119,563.37	678,387.31
应付管理人报酬		5,797.02	8,244.77
应付托管费		1,159.39	1,648.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,906.96	7,692.74
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	39,957.04	140,172.22
负债合计		545,217.43	836,148.36
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	7,849,295.26	9,938,789.58
未分配利润	6.4.7.10	1,676,895.30	2,179,258.06
所有者权益合计		9,526,190.56	12,118,047.64
负债和所有者权益总计		10,071,407.99	12,954,196.00

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2136 元，基金份额总额 7,849,295.26 份。

6.2 利润表

会计主体：方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年1月1日至 2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日
一、收入		63,356.94	3,191,997.25
1.利息收入		2,135.20	59,183.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,135.20	59,173.96
债券利息收入		-	9.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,079,603.31	9,644,496.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,001,451.73	8,697,788.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	21,245.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	78,151.58	925,462.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,024,572.62	-6,787,062.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	6,191.05	275,380.55
减：二、费用		105,666.98	1,068,873.08

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	36,986.25	403,389.14
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,397.22	80,677.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	20,231.73	460,962.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.02
7. 其他费用	6.4.7.20	41,051.78	123,844.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-42,310.04	2,123,124.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-42,310.04	2,123,124.17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	9,938,789.58	2,179,258.06	12,118,047.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-42,310.04	-42,310.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,089,494.32	-460,052.72	-2,549,547.04
其中：1. 基金申购款	5,148,881.82	1,346,881.00	6,495,762.82
2. 基金赎回款	-7,238,376.14	-1,806,933.72	-9,045,309.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	7,849,295.26	1,676,895.30	9,526,190.56

出具了编号为德师报(验)字(19)第 00471 号验资报告。经向中国证监会备案后，基金合同于 2019 年 9 月 26 日正式生效。本基金的基金管理人为方正富邦基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括恒生沪深港通大湾区综合指数成份股、备选成份股、依法发行上市的其他股票(包括港股通标的股票和中国证监会核准发行上市的股票)、债券(国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：恒生沪深港通大湾区综合指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率(税后)×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于 2021 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则以及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需要说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税;

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税;

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利, H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请, 由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利, 由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税;

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税。对于基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税；

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,062,361.90
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	1,062,361.90

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,143,081.22	8,971,063.03	827,981.81
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	8,143,081.22	8,971,063.03	827,981.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	68.31
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	4.12
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	0.80
合计	73.23

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,906.96
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,906.96

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	287.27
应付证券出借违约金	-
预提费用	39,669.77
合计	39,957.04

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,938,789.58	9,938,789.58
本期申购	5,148,881.82	5,148,881.82
本期赎回(以“-”号填列)	-7,238,376.14	-7,238,376.14
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	7,849,295.26	7,849,295.26

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,434,097.57	-1,254,839.51	2,179,258.06
本期利润	982,262.58	-1,024,572.62	-42,310.04
本期基金份额交易产生的变动数	-732,663.78	272,611.06	-460,052.72
其中：基金申购款	2,191,979.44	-845,098.44	1,346,881.00
基金赎回款	-2,924,643.22	1,117,709.50	-1,806,933.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,683,696.37	-2,006,801.07	1,676,895.30

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,647.67
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	411.78
其他	75.75
合计	2,135.20

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,001,451.73
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	1,001,451.73

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	7,411,882.32
减：卖出股票成本总额	6,410,430.59
买卖股票差价收入	1,001,451.73

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	78,151.58
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	78,151.58

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,024,572.62
——股票投资	-1,024,572.62
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-1,024,572.62

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,191.05

合计	6,191.05
----	----------

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	20,231.73
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	20,231.73

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	-
证券出借违约金	-
上市费	29,752.78
银行汇划费	1,382.01
合计	41,051.78

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
方正富邦基金管理有限公司（“方正富邦基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
方正证券股份有限公司（“方正证券”）	基金管理人的股东
富邦证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
北京方正富邦创融资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
方正证券	-	-	13,795,849.05	5.70%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
方正证券	-	-	26,487.59	23.39%

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
方正证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
方正证券	11,062.74	5.26%	11,038.44	53.92%

注 1：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

注 2：该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	36,986.25
其中：支付销售机构的客户维护费	16,777.28	37,850.58

注：支付基金管理人方正富邦基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.75% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,397.22	80,677.75

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的管理人本报告期与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,062,361.90	1,647.67	14,258,345.24	45,539.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人内部控制组织体系包括三个层次：（1）第一层次风险控制：在董事会层面设立风险控制委员会，对公司规章制度、经营管理、基金运作、固有资金投资等方面的合法、合规性进行全面的分析检查，对各种风险预测报告进行审议，提出相应的意见和建议。公司设督

察长。督察长对董事会负责，按照中国证监会的规定和风险控制委员会的授权进行工作。(2) 第二层次风险控制：第二层次风险控制是指公司经营层层面的风险控制，具体为在风险管理委员会、投资决策委员会和合规与风险管理部层次对公司的风险进行的预防和控制。风险管理委员会对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的分析、评估，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。投资决策委员会研究并制定基金资产的投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。合规与风险管理部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。(3) 第三层次风险控制：第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证

券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2021 年 6 月 30 日及 2020 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,062,361.90	-	-	-	1,062,361.90
结算备付金	18,759.40	-	-	-	18,759.40
存出保证金	1,606.88	-	-	211.89	1,818.77
交易性金融资产	-	-	-	8,971,063.03	8,971,063.03
应收利息	-	-	-	73.23	73.23
应收股利	-	-	-	13,125.31	13,125.31
应收申购款	-	-	-	4,206.35	4,206.35
资产总计	1,082,728.18	-	-	8,988,679.81	10,071,407.99

负债					
应付证券清算款	-	-	-	375,833.65	375,833.65
应付赎回款	-	-	-	119,563.37	119,563.37
应付管理人报酬	-	-	-	5,797.02	5,797.02
应付托管费	-	-	-	1,159.39	1,159.39
应付交易费用	-	-	-	2,906.96	2,906.96
其他负债	-	-	-	39,957.04	39,957.04
负债总计	-	-	-	545,217.43	545,217.43
利率敏感度缺口	1,082,728.18	-	-	8,443,462.38	9,526,190.56
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,334,977.12	-	-	-	1,334,977.12
结算备付金	795.49	-	-	-	795.49
存出保证金	8,616.16	-	-	-	8,616.16
交易性金融资产	-	-	-	11,429,485.70	11,429,485.70
应收证券清算款	-	-	-	175,950.27	175,950.27
应收利息	-	-	-	165.93	165.93
应收股利	-	-	-	3,119.45	3,119.45
应收申购款	-	-	-	1,085.88	1,085.88
资产总计	1,344,388.77	-	-	11,609,807.23	12,954,196.00
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2.36	2.36
应付赎回款	-	-	-	678,387.31	678,387.31
应付管理人报酬	-	-	-	8,244.77	8,244.77
应付托管费	-	-	-	1,648.96	1,648.96
应付交易费用	-	-	-	7,692.74	7,692.74
其他负债	-	-	-	140,172.22	140,172.22
负债总计	-	-	-	836,148.36	836,148.36
利率敏感度缺口	1,344,388.77	-	-	10,773,658.87	12,118,047.64

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0% (上年度末：0%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的资产配置采用“自上而下”的多因素分析策略，对全球经济发展形势及中国经济发展所处阶段(包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况、证券市场估值水平等)进行判断，并对股票市场、债券市场未来一段时间内的风险收益特征做出合理预测，据此灵活调整股票、债券、现金三类资产的配置比例。此外，本基金也将根据股市运行周期的演变规律定期，或者根据宏观经济重大变化不定期地进行资产配置比例的调整，保持基金资产配置的有效性，规避市场风险，追求基金资产的长期稳定回报。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中投资于恒生沪深港通大湾区综合指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	8,971,063.03	94.17	11,429,485.70	94.32
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,971,063.03	94.17	11,429,485.70	94.32

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	466,710.28	590,523.79
	业绩比较基准下降 5%	-466,710.28	-590,523.79

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 8,971,063.03 元，无属于第二层级和第三层次的余额。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iv) 第三层次公允价值余额

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第三层次的余额。该层次金融工具公允价值的估值技术为市价折扣法，输入值为流动性折扣，该输入值对公允价值的影响为输入值越高，公允价值越低。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	8,971,063.03	89.07
	其中：股票	8,971,063.03	89.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,081,121.30	10.73
8	其他各项资产	19,223.66	0.19
9	合计	10,071,407.99	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 4,506,015.51 元，占基金资产净值比例为 47.30%。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	8,331.00	0.09
C	制造业	2,380,295.18	24.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	36,459.10	0.38
E	建筑业	4,977.00	0.05
F	批发和零售业	30,086.44	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	116,073.00	1.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	102,812.00	1.08
J	金融业	1,323,653.80	13.89
K	房地产业	299,154.00	3.14
L	租赁和商务服务业	11,271.00	0.12

M	科学研究和技术服务业	67,548.00	0.71
N	水利、环境和公共设施管理业	17,364.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	31,954.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	35,069.00	0.37
	合计	4,465,047.52	46.87

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票投资组合（指数基金）。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	25,486.61	0.27
B 消费者非必需品	461,628.71	4.85
C 消费者常用品	141,052.00	1.48
D 能源	-	-
E 金融	1,771,939.27	18.60
F 医疗保健	44,681.87	0.47
G 工业	135,849.53	1.43
H 信息技术	1,015,667.85	10.66
I 电信服务	20,119.70	0.21
J 公用事业	134,966.01	1.42
K 房地产	754,623.96	7.92
合计	4,506,015.51	47.30

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	1,800	874,682.50	9.18
2	01299	友邦保险	9,200	738,720.62	7.75
3	601318	中国平安	7,100	456,388.00	4.79
4	00388	香港交易所	901	346,963.05	3.64
5	000001	平安银行	14,900	337,038.00	3.54
6	02318	中国平安	5,000	316,398.42	3.32
7	000333	美的集团	3,730	266,210.10	2.79

8	000651	格力电器	4,400	229,240.00	2.41
9	600036	招商银行	3,900	211,341.00	2.22
10	300760	迈瑞医疗	400	192,020.00	2.02
11	03968	招商银行	3,000	165,375.90	1.74
12	600030	中信证券	6,100	152,134.00	1.60
13	603288	海天味业	1,174	151,387.30	1.59
14	002594	比亚迪	600	150,600.00	1.58
15	000002	万科 A	5,200	123,812.00	1.30
16	00291	华润啤酒	2,000	116,075.16	1.22
17	00027	银河娱乐	2,000	103,427.54	1.09
18	300014	亿纬锂能	954	99,149.22	1.04
19	01211	比亚迪股份	500	96,604.49	1.01
20	00016	新鸿基地产	1,000	96,271.66	1.01
21	300124	汇川技术	1,250	92,825.00	0.97
22	00003	香港中华煤气	8,662	86,922.17	0.91
23	002352	顺丰控股	1,200	81,240.00	0.85
24	00011	恒生银行	600	77,433.36	0.81
25	000100	TCL 科技	9,700	74,205.00	0.78
26	000063	中兴通讯	2,200	73,106.00	0.77
27	06098	碧桂园服务	988	68,973.77	0.72
28	01113	长实集团	1,500	66,899.23	0.70
29	600048	保利地产	5,500	66,220.00	0.70
30	02388	中银香港	3,009	65,973.25	0.69
31	600999	招商证券	3,390	64,477.80	0.68
32	01928	金沙中国有限公司	2,000	54,418.03	0.57
33	00066	港铁公司	1,500	53,981.19	0.57
34	00868	信义玻璃	2,000	52,670.66	0.55
35	01109	华润置地	1,993	52,154.65	0.55
36	300454	深信服	200	51,896.00	0.54
37	002311	海大集团	600	48,960.00	0.51
38	002709	天赐材料	444	47,321.52	0.50
39	300601	康泰生物	300	44,700.00	0.47
40	00268	金蝶国际	2,000	43,850.62	0.46
41	02007	碧桂园	6,002	43,449.05	0.46
42	01997	九龙仓置业	1,002	37,643.55	0.40
43	002841	视源股份	300	37,287.00	0.39
44	300012	华测检测	1,100	35,068.00	0.37
45	000776	广发证券	2,300	34,822.00	0.37

46	00867	康哲药业	2,000	34,032.07	0.36
47	600383	金地集团	3,300	33,792.00	0.35
48	00909	明源云	1,000	32,076.68	0.34
49	603882	金域医学	200	31,954.00	0.34
50	00101	恒隆地产	2,000	31,386.06	0.33
51	600143	金发科技	1,500	31,290.00	0.33
52	002340	格林美	3,300	30,855.00	0.32
53	00012	恒基地产	1,000	30,620.54	0.32
54	300529	健帆生物	340	29,362.40	0.31
55	000009	中国宝安	1,600	29,232.00	0.31
56	601138	工业富联	2,300	28,543.00	0.30
57	06666	恒大物业	3,500	28,394.73	0.30
58	002008	大族激光	700	28,273.00	0.30
59	01209	华润万象生活	600	26,535.03	0.28
60	09922	九毛九	1,000	26,418.54	0.28
61	02202	万科企业	1,300	26,285.41	0.28
62	300207	欣旺达	800	26,048.00	0.27
63	603160	汇顶科技	200	25,926.00	0.27
64	00014	希慎兴业	1,000	25,752.88	0.27
65	00017	新世界发展	750	25,180.82	0.26
66	00004	九龙仓集团	1,000	24,629.57	0.26
67	06030	中信证券	1,500	24,313.38	0.26
68	300676	华大基因	200	23,720.00	0.25
69	002736	国信证券	2,200	23,650.00	0.25
70	01929	周大福	1,600	23,617.76	0.25
71	000069	华侨城 A	3,100	23,064.00	0.24
72	002797	第一创业	3,200	22,848.00	0.24
73	601636	旗滨集团	1,200	22,272.00	0.23
74	00285	比亚迪电子	500	21,218.04	0.22
75	600183	生益科技	900	21,069.00	0.22
76	002625	光启技术	1,000	20,810.00	0.22
77	000066	中国长城	1,400	20,440.00	0.21
78	00083	信和置业	2,000	20,369.32	0.21
79	300037	新宙邦	200	20,020.00	0.21
80	300146	汤臣倍健	600	19,740.00	0.21
81	001979	招商蛇口	1,800	19,710.00	0.21
82	002791	坚朗五金	100	19,405.00	0.20
83	002138	顺络电子	500	19,385.00	0.20
84	00270	粤海投资	2,034	18,887.75	0.20

85	00144	招商局港口	2,000	18,871.57	0.20
86	01999	敏华控股	1,200	18,631.94	0.20
87	000039	中集集团	1,000	18,180.00	0.19
88	00148	建滔集团	500	17,931.32	0.19
89	002916	深南电路	160	17,780.80	0.19
90	00836	华润电力	2,000	17,640.10	0.19
91	002600	领益智造	1,900	17,461.00	0.18
92	603833	欧派家居	120	17,035.20	0.18
93	300482	万孚生物	260	16,819.40	0.18
94	600872	中炬高新	400	16,808.00	0.18
95	00010	恒隆集团	1,000	16,475.18	0.17
96	002180	纳思达	500	16,100.00	0.17
97	03319	雅生活服务	500	16,079.95	0.17
98	003816	中国广核	6,000	16,020.00	0.17
99	02128	中国联塑	1,000	15,942.65	0.17
100	00336	华宝国际	1,000	15,576.54	0.16
101	01972	太古地产	800	15,410.12	0.16
102	000012	南玻 A	1,500	15,360.00	0.16
103	002030	达安基因	716	15,207.84	0.16
104	00754	合生创展集团	500	14,811.02	0.16
105	00839	中教控股	1,000	14,411.63	0.15
106	00023	东亚银行	1,200	14,398.31	0.15
107	601238	广汽集团	1,100	14,245.00	0.15
108	00880	澳博控股	2,000	14,112.08	0.15
109	002511	中顺洁柔	500	13,775.00	0.14
110	600332	白云山	400	13,540.00	0.14
111	603233	大参林	264	13,493.04	0.14
112	002152	广电运通	1,000	13,030.00	0.14
113	000050	深天马 A	900	12,762.00	0.13
114	002456	欧菲光	1,400	12,432.00	0.13
115	002465	海格通信	1,300	12,298.00	0.13
116	01313	华润水泥控股	2,000	12,281.50	0.13
117	01128	永利澳门	1,200	12,201.62	0.13
118	002572	索菲亚	500	12,100.00	0.13
119	00763	中兴通讯	597	12,046.23	0.13
120	00200	新濠国际发展	1,000	11,865.46	0.12
121	02238	广汽集团	2,005	11,628.19	0.12
122	300724	捷佳伟创	100	11,601.00	0.12
123	01816	中广核电力	8,000	11,515.99	0.12

124	601615	明阳智能	700	11,333.00	0.12
125	002920	德赛西威	100	11,008.00	0.12
126	600380	健康元	800	10,984.00	0.12
127	00683	嘉里建设	500	10,650.62	0.11
128	000027	深圳能源	1,140	10,453.80	0.11
129	600029	南方航空	1,700	10,234.00	0.11
130	00008	电讯盈科	3,000	10,159.70	0.11
131	300115	长盈精密	480	9,888.00	0.10
132	002294	信立泰	300	9,870.00	0.10
133	03380	龙光集团	1,000	9,668.77	0.10
134	300737	科顺股份	300	9,432.00	0.10
135	002851	麦格米特	300	9,369.00	0.10
136	06993	蓝月亮集团	1,000	9,136.24	0.10
137	600004	白云机场	800	8,944.00	0.09
138	00152	深圳国际	1,000	8,936.54	0.09
139	002831	裕同科技	300	8,907.00	0.09
140	300616	尚品宅配	100	8,851.00	0.09
141	02777	富力地产	1,200	8,846.67	0.09
142	300376	易事特	1,100	8,844.00	0.09
143	03311	中国建筑国际	2,000	8,820.05	0.09
144	06049	保利物业	200	8,770.12	0.09
145	002967	广电计量	200	8,760.00	0.09
146	300476	胜宏科技	400	8,740.00	0.09
147	002850	科达利	100	8,740.00	0.09
148	600323	瀚蓝环境	400	8,716.00	0.09
149	01813	合景泰富集团	1,000	8,653.63	0.09
150	002429	兆驰股份	1,400	8,498.00	0.09
151	002683	宏大爆破	300	8,331.00	0.09
152	02689	玖龙纸业	1,000	8,287.52	0.09
153	00136	恒腾网络	1,600	8,267.55	0.09
154	00123	越秀地产(新)	1,200	8,167.70	0.09
155	600728	佳都科技	1,100	8,151.00	0.09
156	600325	华发股份	1,200	8,088.00	0.08
157	000999	华润三九	300	8,025.00	0.08
158	01055	中国南方航空股份	2,000	8,021.25	0.08
159	02282	美高梅中国	800	7,828.21	0.08
160	01310	香港宽频	1,000	7,821.55	0.08
161	002939	长城证券	700	7,791.00	0.08

162	002191	劲嘉股份	700	7,448.00	0.08
163	01233	时代中国控股	1,000	7,388.87	0.08
164	300348	长亮科技	400	7,320.00	0.08
165	01888	建滔积层板	500	7,247.42	0.08
166	06099	招商证券	800	7,189.17	0.08
167	002002	鸿达兴业	1,800	7,074.00	0.07
168	00659	新创建集团	1,000	6,872.98	0.07
169	000967	盈峰环境	1,000	6,870.00	0.07
170	002670	国盛金控	600	6,834.00	0.07
171	002249	大洋电机	1,300	6,825.00	0.07
172	01776	广发证券	800	6,696.58	0.07
173	01686	新意网集团	1,000	6,615.04	0.07
174	000987	越秀金控	500	6,330.00	0.07
175	002183	怡亚通	1,100	6,303.00	0.07
176	600685	中船防务	300	6,240.00	0.07
177	03320	华润医药	1,500	6,040.90	0.06
178	300457	赢合科技	300	5,958.00	0.06
179	002867	周大生	300	5,931.00	0.06
180	600185	格力地产	800	5,896.00	0.06
181	600673	东阳光	1,300	5,837.00	0.06
182	000555	神州信息	400	5,788.00	0.06
183	600446	金证股份	400	5,776.00	0.06
184	603228	景旺电子	220	5,764.00	0.06
185	02039	中集集团	400	5,711.40	0.06
186	002285	世联行	900	5,517.00	0.06
187	00293	国泰航空	1,000	5,458.44	0.06
188	03883	中国奥园	1,000	5,450.12	0.06
189	000089	深圳机场	700	5,439.00	0.06
190	601139	深圳燃气	800	5,248.00	0.06
191	001914	招商积余	300	5,154.00	0.05
192	601333	广深铁路	2,400	5,088.00	0.05
193	002416	爱施德	500	5,015.00	0.05
194	000513	丽珠集团	100	5,002.00	0.05
195	000090	天健集团	900	4,977.00	0.05
196	000061	农产品	900	4,968.00	0.05
197	00535	金地商置	6,000	4,942.56	0.05
198	02314	理文造纸	1,000	4,917.59	0.05
199	01638	佳兆业集团	2,008	4,912.20	0.05
200	300232	洲明科技	500	4,465.00	0.05

201	000921	海信家电	300	4,311.00	0.05
202	002317	众生药业	500	4,305.00	0.05
203	002421	达实智能	1,100	4,224.00	0.04
204	002912	中新赛克	100	4,097.00	0.04
205	000685	中山公用	500	4,080.00	0.04
206	002351	漫步者	300	4,062.00	0.04
207	00604	深圳控股	2,000	3,977.34	0.04
208	000078	海王生物	1,200	3,912.00	0.04
209	300770	新媒股份	80	3,896.00	0.04
210	000028	国药一致	100	3,784.00	0.04
211	300602	飞荣达	212	3,773.60	0.04
212	300735	光弘科技	300	3,648.00	0.04
213	002035	华帝股份	500	3,610.00	0.04
214	603043	广州酒家	140	3,600.80	0.04
215	00665	海通国际	2,000	3,561.30	0.04
216	300085	银之杰	200	3,530.00	0.04
217	000006	深振业 A	700	3,507.00	0.04
218	001872	招商港口	200	3,384.00	0.04
219	002042	华孚时尚	700	3,381.00	0.04
220	300377	赢时胜	300	3,342.00	0.04
221	002461	珠江啤酒	300	3,282.00	0.03
222	000070	特发信息	400	3,248.00	0.03
223	002292	奥飞娱乐	500	3,240.00	0.03
224	01513	丽珠医药	100	3,182.71	0.03
225	00173	嘉华国际	1,000	3,136.94	0.03
226	000881	中广核技	300	3,096.00	0.03
227	03813	宝胜国际	2,000	3,045.41	0.03
228	000031	大悦城	800	2,880.00	0.03
229	002243	力合科创	300	2,853.00	0.03
230	02356	大新银行集团	400	2,852.37	0.03
231	03990	美的置业	200	2,735.88	0.03
232	002503	搜于特	1,700	2,669.00	0.03
233	002544	杰赛科技	200	2,668.00	0.03
234	000810	创维数字	300	2,553.00	0.03
235	00525	广深铁路股份	2,000	2,512.88	0.03
236	01212	利福国际	500	2,479.60	0.03
237	002419	天虹股份	365	2,394.40	0.03
238	002672	东江环保	300	2,247.00	0.02
239	603328	依顿电子	300	2,235.00	0.02

240	01883	中信国际电讯	1,000	2,138.45	0.02
241	300634	彩讯股份	100	2,124.00	0.02
242	01788	国泰君安国际	2,000	2,063.56	0.02
243	601330	绿色动力	200	1,778.00	0.02
244	600548	深高速	200	1,744.00	0.02
245	000029	深深房 A	200	1,514.00	0.02
246	000025	特力 A	100	1,488.00	0.02
247	01558	东阳光药	200	1,426.19	0.01
248	00895	东江环保	200	720.58	0.01
249	002911	佛燃能源	70	657.30	0.01
250	00345	VITASOYINT' L	11	264.06	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	482,282.16	3.98
2	01299	友邦保险	393,820.99	3.25
3	601318	中国平安	385,046.00	3.18
4	02318	中国平安	213,566.39	1.76
5	000333	美的集团	167,176.00	1.38
6	00388	香港交易所	165,723.57	1.37
7	000001	平安银行	159,789.00	1.32
8	300014	亿纬锂能	151,325.00	1.25
9	000651	格力电器	129,000.00	1.06
10	300601	康泰生物	107,430.00	0.89
11	600036	招商银行	99,803.00	0.82
12	603288	海天味业	83,817.00	0.69
13	300760	迈瑞医疗	80,931.00	0.67
14	600030	中信证券	76,442.00	0.63
15	01193	华润燃气	73,348.00	0.61
16	000002	万科 A	67,274.00	0.56
17	00017	新世界发展	64,368.17	0.53

18	06666	恒大物业	52,252.34	0.43
19	603160	汇顶科技	52,045.00	0.43
20	03968	招商银行	52,025.87	0.43

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	669,586.36	5.53
2	01299	友邦保险	628,253.16	5.18
3	601318	中国平安	466,825.00	3.85
4	000333	美的集团	303,830.00	2.51
5	00388	香港交易所	277,679.93	2.29
6	000001	平安银行	256,186.00	2.11
7	02318	中国平安	227,229.34	1.88
8	000651	格力电器	223,774.00	1.85
9	300014	亿纬锂能	168,816.00	1.39
10	600036	招商银行	166,342.00	1.37
11	01193	华润燃气	145,836.67	1.20
12	603288	海天味业	141,183.00	1.17
13	600030	中信证券	140,524.00	1.16
14	000002	万科 A	119,570.00	0.99
15	300601	康泰生物	110,200.00	0.91
16	00017	新世界发展	98,704.48	0.81
17	01113	长实集团	91,750.38	0.76
18	300760	迈瑞医疗	88,203.00	0.73
19	002352	顺丰控股	87,175.00	0.72
20	002594	比亚迪	81,834.00	0.68

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,949,388.58
卖出股票收入（成交）总额	7,411,882.32

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,818.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	13,125.31
4	应收利息	73.23
5	应收申购款	4,206.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	19,223.66

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,362	5,763.07	-	-	7,849,295.26	100.00%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	周曲	127,400.00	11.98%
2	殷动合	115,000.00	10.81%
3	邵常红	112,200.00	10.55%
4	钱中明	91,930.00	8.64%
5	廖益民	90,000.00	8.46%
6	王琦	40,627.00	3.82%
7	张向琼	29,800.00	2.80%
8	张志赟	29,700.00	2.79%
9	陈莉	29,500.00	2.77%
10	梁朋	19,700.00	1.85%

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	19,459.99	0.25%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 9 月 26 日）基金份额总额	303,741,891.26
本报告期期初基金份额总额	9,938,789.58
本报告期基金总申购份额	5,148,881.82
减:本报告期基金总赎回份额	7,238,376.14
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	7,849,295.26

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

德勤华永会计师事务所为本基金提供审计服务，报告期内未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	3	6,733,973.05	54.60%	4,467.58	53.83%	-
天风证券	2	3,542,394.91	28.72%	2,356.78	28.39%	-
国盛证券	2	2,057,710.98	16.68%	1,475.58	17.78%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

大通证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	9	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-

注：1、为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

2、券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
东吴证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	方正富邦基金管理有限公司关于住所变更的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021 年 1 月 4 日
2	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）2020 年第 4 季度报告	证券日报、公司网站	2021 年 1 月 21 日
3	关于增聘方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）基金经理的公告	证券日报、公司网站	2021 年 2 月 2 日

4	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）招募说明书（2021 年 2 月更新）	证券日报、公司网站	2021 年 2 月 4 日
5	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）基金产品资料概要（更新）	证券日报、公司网站	2021 年 2 月 4 日
6	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、公司网站	2021 年 2 月 5 日
7	方正富邦基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021 年 3 月 26 日
8	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、公司网站	2021 年 3 月 30 日
9	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）2020 年年度报告	证券日报、公司网站	2021 年 3 月 30 日
10	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）基金合同（2021 年 3 月更新）	证券日报、公司网站	2021 年 3 月 31 日
11	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）托管协议（2021 年 3 月更新）	证券日报、公司网站	2021 年 3 月 31 日
12	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）招募说明书（2021 年 3 月更新）	证券日报、公司网站	2021 年 3 月 31 日
13	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）基金产品资料概要（更新）	证券日报、公司网站	2021 年 3 月 31 日
14	关于根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改旗下 9 只基金基金合同部分条款的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021 年 3 月 31 日
15	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）2021 年第 1 季度报告	证券日报、公司网站	2021 年 4 月 22 日
16	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、公司网站	2021 年 4 月 27 日
17	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区	证券日报、公司网站	2021 年 4 月 30 日

	区综合指数证券投资基金（LOF） 溢价风险的提示公告		
18	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF） 溢价风险的提示公告	证券日报、公司网站	2021 年 5 月 6 日
19	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF） 暂停及恢复申购、赎回及定期定额 投资业务的公告	证券日报、公司网站	2021 年 5 月 17 日
20	方正富邦恒生沪深港通大湾区综 合指数证券投资基金（LOF）基金 合同	证券日报、公司网站	2021 年 5 月 31 日
21	方正富邦恒生沪深港通大湾区综 合指数证券投资基金（LOF）托管 协议	证券日报、公司网站	2021 年 5 月 31 日
22	方正富邦恒生沪深港通大湾区综 合指数证券投资基金（LOF）招募 说明书（更新）	证券日报、公司网站	2021 年 5 月 31 日
23	关于旗下部分基金根据《公开募集 证券投资基金侧袋机制指引（试 行）》修改基金合同部分条款的公 告	中证报、上证报、证 券日报、证券时报、 公司网站	2021 年 5 月 31 日
24	方正富邦恒生沪深港通大湾区综 合指数证券投资基金（LOF）基金 产品资料概要（更新）	证券日报、公司网站	2021 年 6 月 3 日
25	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF） 暂停及恢复申购、赎回及定期定额 投资业务的公告	证券日报、公司网站	2021 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （1）中国证监会核准基金募集的文件；
- （2）《方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- （3）《方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- （4）《方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- （5）基金管理人业务资格批件、营业执照；
- （6）基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

方正富邦基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日